

Title	マルコフ型決定過程における最適政策 (制御過程論 III)
Author(s)	古川, 長太
Citation	数理解析研究所講究録 (1971), 128: 25-39
Issue Date	1971-11
URL	<a href="http://hdl.handle.net/2433/106550">http://hdl.handle.net/2433/106550</a>
Right	
Type	Departmental Bulletin Paper
Textversion	publisher

## マルコフ型決定過程における最適政策

九大 理学部 古川 長太

### 第1章 最適政策の存在と構成

#### §1. 準備

Borel set : ある complete separable metric space の Borel subset

$X, Y$  : Borel set

$\mathcal{B}(X)$  :  $X$  における Borel field

$\mathcal{B}(Y)$  :  $Y$  における Borel field

$\mathcal{P}(X)$  :  $X$  上の確率測度の全体

$F(x)$  :  $X$  上で定義された集合値関数で

$$F(x) \subset Y \quad \forall x \in X$$

をみたす。

$\mathcal{Q}(\{F(x)\} | X)$  : つぎの (i), (ii), (iii) をみたす条件付確率測度  $g$  の全体

(i) 各  $x \in X$  に対し,  $g(\cdot | x)$  は  $\mathcal{B}(Y)$  上の確率測度

(ii)  $g(F(x) | x) = 1 \quad \forall x \in X$

(iii) 各  $B \in \mathcal{B}(Y)$  に対し,  $g(B | \cdot)$  は  $Y$  上の  $\mathcal{B}(X)$  可測関数

$M(Z)$  : Borel set  $Z$  上の有界 Borel 可測関数の全体

$A$  を  $n$  次元ユークリッド空間  $R^n$  の compact subset,  $R^n$  の座標を  $\{x_1, x_2, \dots, x_n\}$  とする。

$$A_{x_1} \equiv \{y : y \in A, (x_1, y) = \max_{z \in A} (x_1, z)\}$$

以下帰納的に

$$A_{x_1 x_2 \dots x_i} \equiv \{y : y \in A_{x_1 x_2 \dots x_{i-1}}, (x_i, y) = \max_{z \in A_{x_1 \dots x_{i-1}}} (x_i, z)\}$$

$e(A) \equiv A_{x_1 x_2 \dots x_n}$  は 1 点として定まる。 $e(A)$  を,  $A$  の lexicographic maximum と云う。

## §2. Selector の定理

$X$  : Borel set

$Y$  : compact metric space

$2^Y$  :  $Y$  の closed subset の全体

$\mathcal{B}(2^Y)$  :  $2^Y$  における Hausdorff metric  $h$  で生成された Borel field

### 補題 2.1

$F(x) \in 2^Y \quad \forall x \in X$ , かつ  $F(\cdot) \in \mathcal{B}(X) / \mathcal{B}(2^Y)$

ならば

$$\{(x, F(x)) ; x \in X\} \in \mathcal{B}(X) \otimes \mathcal{B}(Y)$$

補題 2.2

$g \in Q(\{F(x)\} | X)$  なる  $g$  と,  $g(\Gamma_x | x) > 0 \quad \forall x \in X$

かつ  $\Gamma_x \subset F(x) \quad \forall x \in X$  なる  $\Gamma \in \mathcal{B}(X) \otimes \mathcal{B}(Y)$  に対して,

$$(x, f(x)) \in \Gamma \quad \forall x \in X$$

なる  $\mathcal{B}(X)$  可測な  $f$  が存在する。

補題 2.3

$F(x) \in 2^Y \quad \forall x \in X$  かつ  $F(\cdot) \in \mathcal{B}(X) / \mathcal{B}(2^Y)$  とする。

このとき, 任意の  $g \in Q(\{F(x)\} | X)$ , 任意の  $u \in M(\{(x, F(x)); x \in X\})$ , 任意の  $\varepsilon > 0$  に対して

$$(i) \quad fu \geq gu \quad \text{かつ} \quad f(x) \in F(x) \quad \forall x \in X$$

なる  $\mathcal{B}(X)$  可測関数  $f$  が存在する。

$$(ii) \quad g(\{y \in F(x_0); u(x_0, y) \leq u(x_0, f(x_0)) + \varepsilon\} | x_0) = 1 \quad \forall x_0 \in X$$

$$\text{かつ} \quad f(x) \in F(x) \quad \forall x \in X$$

なる  $\mathcal{B}(X)$  可測関数  $f$  が存在する。

§3.  $(p, \varepsilon)$ -optimal stationary policy と optimality equation

マルコフ型決定過程の記号と定義

$S$ : state space (ある Borel set)

$A$ : ある compact metric space

$A(s)$  : state  $s$  における feasible action の空間で,

$$A(s) \in 2^A \quad \forall s \in S \quad \text{および} \quad A(\cdot) \in \mathcal{B}(S)/\mathcal{B}(2^A)$$

をみたすものとする。

$$D \equiv \{(s, A(s)) ; s \in S\}$$

補題 2.1 により  $D \in \mathcal{B}(S) \otimes \mathcal{B}(A)$  となる。

$q$  : 推移確率測度で  $q \in \mathcal{Q}(S|D)$  とする。

$r$  : 利得関数で  $r \in M(S \times A)$  とする。

$\beta$  : 割引率で  $0 \leq \beta < 1$  とする。

$$H_n \equiv DD \cdots DS \quad (n \text{ factors})$$

$\pi = \{\pi_1, \pi_2, \pi_3, \dots\}$  : 政策 (policy) で

$$\pi_n \in \mathcal{Q}(\{A(s)\} | H_n) \quad n=1, 2, \dots \quad \text{とする。}$$

$$I(\pi) = \sum_{n=1}^{\infty} \beta^{n-1} \pi_1 q \pi_2 q \cdots \pi_n q r : \text{policy } \pi \text{ による総利得の期待値}$$

補題 3.1 任意の  $p \in \mathcal{P}(S)$ , 任意の  $\varepsilon > 0$  に対して

$(p, \varepsilon)$ -optimal policy が存在する。

補題 3.2 任意の  $p \in \mathcal{P}(S)$ , 任意の  $\pi$ , 任意の  $\varepsilon > 0$  に

対して,  $\pi$  を  $(p, \varepsilon)$ -dominate する Markov policy が存在する。

定理 3.1 任意の  $p \in \mathcal{P}(S)$ , 任意の  $\varepsilon > 0$  に対して

$(p, \varepsilon)$ -optimal Markov policy が存在する。

Operator  $L_f$ , Operator  $L_a$  をつぎのように定義する.

$f(s) \in A(s) \quad \forall s \in S$  なる  $B(S)$  可測関数  $f$  と,

$u \in M(S)$  に対して

$$L_f u(s) = \int_S [r(s, f(s), t) + \beta u(t)] dq(t|s, f(s)) \quad \forall s \in S$$

$a \in A(s)$ ,  $u \in M(S)$  に対して

$$L_a u(s) = \int_S [r(s, a, t) + \beta u(t)] dq(t|s, a)$$

Optimality equation

$u \in M(S)$  が

$$u(s) = \sup_{a \in A(s)} L_a u(s) \quad \forall s \in S$$

をみたすとき,  $u$  は optimality equation をみたすことになる.

### 定理 3.2

(a) 任意の  $p \in P(S)$ , 任意の  $\varepsilon > 0$  に対して  $(p, \varepsilon)$ -optimal stationary policy が存在する.

(b) もしも  $\varepsilon$ -optimal policy が存在すれば,  $\varepsilon/(1-\beta)$ -optimal stationary policy が存在する ( $\varepsilon \geq 0$ ).

(c)  $u \in M(S)$  に対して

$$L_a u(s) \leq u(s) \quad \forall a \in A(s), \forall s \in S$$

ならば

$$I(\pi) \leq u \quad \forall \pi$$

が成立する。

(d)  $\pi$  が最適であることと,  $I(\pi)$  が optimality equation をみたすこととは同値である。

#### §4. Optimal stationary policy

##### 補題 4.1

$A: \mathbb{R}^n$  の compact subset

$S$ : Borel set

$u(s, a): SA \rightarrow \mathbb{R}^m$  なる mapping で 有界 かつ

各  $a$  に対し,  $s$  につき  $\mathcal{B}(S)$  可測

各  $s$  に対し,  $a$  につき 連続 とする。

$X^m: \mathbb{R}^m$  の compact subset の全体

このとき,  $U(s) \equiv u(s, A) \equiv \{x: x = u(s, a), a \in A\}$  は

$S \rightarrow X^m$  なる mapping で  $U(\cdot) \in \mathcal{B}(S)/\mathcal{B}(X^m)$  となる。

##### 仮定 (I)

$A$  は  $\mathbb{R}^n$  の compact subset で,  $A(s) \in 2^A \quad \forall s \in S$  かつ

$A(\cdot) \in \mathcal{B}(S)/\mathcal{B}(2^A)$

補題 4.2

(I) を仮定し,  $u(s, a)$  について 補題 4.1 と同じ仮定をおく。  
 このとき  $\tilde{U}(s) \equiv u(s, A(s)) \equiv \{x; x = u(s, a), a \in A(s)\}$  は  
 $S \rightarrow X^m$  なる mapping で  $\tilde{U}(\cdot) \in \mathcal{B}(S)/\mathcal{B}(X^m)$  となる。

補題 4.3

$G(s) : S \rightarrow X^n$  への mapping で 有界かつ  $G(\cdot) \in \mathcal{B}(S)/\mathcal{B}(X^n)$   
 とすると,  $e(G(s))$  は  $S \rightarrow R^n$  への  $\mathcal{B}(S)$  可測関数である。

補題 4.4 (可測閉関数の補題)

$A : R^n$  の compact subset

$u$  については 補題 4.1 と同じ仮定をおく。

$$U(s) \equiv u(s, A)$$

$\phi(s) : S \rightarrow R^m$  への  $\mathcal{B}(S)$  可測 map で かつ,

$$\phi(s) \in U(s) \quad \forall s \in S$$

とする。このとき

$$\phi(s) = u(s, f(s)) \quad \forall s \in S$$

をみたす  $S \rightarrow A$  への  $\mathcal{B}(S)$  可測関数  $f$  が存在する。

補題 4.5 (可測閉関数の補題)

(I) を仮定する。  $u$  について 補題 4.1 と同じ仮定をおく。

$$\tilde{U}(s) \equiv u(s, A(s))$$

$\phi(s) : S \rightarrow R^m$  への  $\mathcal{B}(S)$  可測 map で かつ

$$\phi(s) \in \tilde{U}(s) \quad \forall s \in S$$



とする。このとき

$$f(s) \in A(s) \quad \forall s \in S$$

$$\phi(s) = u(s, f(s)) \quad \forall s \in S$$

をみたす  $B(S)$  可測関数  $f$  が存在する。

定理 4.1 (I) を仮定し,  $u$  については  $m=1$  として 補題 4.1 と同じ仮定をおく。このとき

$$f(s) \in A(s) \quad \forall s \in S,$$

$$u(s, f(s)) = \max_{a \in A(s)} u(s, a) \quad \forall s \in S$$

をみたす  $B(S)$  可測関数  $f$  が存在する。

仮定 (II)  $\gamma \in M(SA)$ ,  $\gamma$  は 各  $s$  に対し,  $a \in A$  につき連続とする。

仮定 (III) 各  $s$  に対し, いかなる有界可測関数  $w(\cdot)$  に対しても

$$\int_S w(\cdot) d\gamma(\cdot | s, a) \quad \text{が} \quad a \in A \text{ につき連続とする。}$$

Operator  $T$  を つきのように定義する:

$w \in M(S)$  に対し

$$Tw(s) = \max_{a \in A(s)} \left[ \int_S \{ \gamma(s, a) + \beta w(\cdot) \} d\gamma(\cdot | s, a) \right]$$

定理 4.2 仮定 (I), (II), (III) をおく。このとき, optimal stationary policy が存在する。

## §5. Policy improvement

$N$  : measurable space  $(S, \mathcal{B}(S))$  上の Markov kernel

$E$  : measurable space  $(S, \mathcal{B}(S))$  上の Markov identity kernel

$S$  上の実数値  $\mathcal{B}(S)$  可測関数  $f$  に対して

$$h = \lim_{n \rightarrow \infty} (E + \beta N + \beta^2 N^2 + \cdots + \beta^n N^n) f$$

が well-defined かつ有限のとき,  $f$  は  $\beta$ -charge であるとき,

$h$  を  $f$  の  $\beta$ -Potential と置く。

$$G \equiv \sum_{n=0}^{\infty} (\beta N)^n : \beta\text{-Potential kernel}$$

補題 5.1 任意の  $h \in M(S)$  に対して,  $f = (E - \beta N)h$  とおくと,

$h$  は  $f$  の  $\beta$ -Potential であり,  $h = Gf$  となる。

補題 5.2  $f_1, f_2$  はともに  $\mathcal{B}(S)$  可測で  $f_i(\omega) \in A(\omega)$

$\forall \omega \in S$  ( $i=1, 2$ ) とする。このとき

$$L_{f_2} I(f_1^\infty) \geq I(f_1^\infty) \text{ ならば } I(f_2^\infty) \geq I(f_1^\infty)$$

$$L_{f_2} I(f_1^\infty) \leq I(f_1^\infty) \text{ ならば } I(f_2^\infty) \leq I(f_1^\infty)$$

となる。

定理 5.1 (I), (II), (III) を仮定する。

(i)  $\mathcal{B}(S)$  可測な  $f_0 : f_0(s) \in A(s) \quad \forall s \in S$  を任意に与える。

(ii) 各  $n \geq 0$  について, つぎの手順を行う。

$$L_{f_{n+1}} I(f_n^\infty) = T I(f_n^\infty)$$

なる  $\mathcal{B}(S)$  可測な  $f_{n+1} (f_{n+1}(s) \in A(s) \quad \forall s \in S)$  を求める。

このとき

(a)  $I(f_0^\infty) \leq I(f_1^\infty) \leq \dots \leq I(f_n^\infty) \leq I(f_{n+1}^\infty) \leq \dots \uparrow \sup_{\pi} I(\pi)$

(b) もしある  $n_0$  で  $f_{n_0} = f_{n_0+1}$  となれば  $f_{n_0}^\infty$  は optimal policy である。

## 第2章 確率オートマトンとの関連

Probabilistic automaton  $\mathcal{A} = (\Sigma, S, Q)$

$\Sigma$  : input alphabet (finite set)

$S$  : state space (denumerable set)

$Q : \Sigma \rightarrow Q(S|S)$  なる map

$\Sigma^* = W(\Sigma)$  :  $\Sigma$  上の words の全体

$Q$  は  $\Sigma^* \rightarrow Q(S|S)$  へ 拡張される

$x = \sigma_1 \sigma_2 \cdots \sigma_n$  に対し  $Q(x) \equiv Q(\sigma_1)Q(\sigma_2) \cdots Q(\sigma_n)$  とおく。

Prop. 1 オイ章で特に  $S, A$  finite ( $A$ は一定) の場合を考えると, これはつきのような 利得をもつ Mealy type の確率オートマトン  $(Q(\Sigma, S, Q), \gamma)$  で表わされる。

$\Sigma: S \rightarrow A$  なる map の全体 (finite)

$\gamma: S\Sigma \rightarrow R^1$  なる 利得関数で,  $\gamma(s, \sigma) = \gamma(s, \sigma(s))$  をみたす。

Def. 利得をもつ確率オートマトン

確率オートマトン  $Q = (\Sigma, S, Q, F)$

ただし  $Q: \Sigma \rightarrow Q(S|S)$

$F: F \subset S$ , final state の集合

$g, R$  とともに 利得関数で "つき" の性質をもつとする。

$$E^{\sigma_1 \sigma_2 \cdots \sigma_m \cdots \sigma_n} g = E^{\sigma_1 \cdots \sigma_m \cdots \sigma_n} g (E^{\sigma_1 \cdots \sigma_m} g, s_{m+1}, \dots, s_{n+1})$$

$$\forall (\sigma_1 \cdots \sigma_n) \in \Sigma^*$$

$R$  は  $(\sigma_1 \cdots \sigma_n)$  に対し  $s_{n+1}$  のみの関数:

$$E^{\sigma_1 \cdots \sigma_n} R(s_{n+1})$$

empty word  $\lambda$  に対して

$$E^\lambda g = 0, \quad E^\lambda R = R(s_1)$$

以上の仮定のもとで,  $\Pi = (\sigma, g, k)$  を利得のある確率オートマトンと云う。

Def. 利得をもつ確率オートマトン  $\Pi$  における最適化問題は,

$$\begin{aligned} E^x(g+k) &\rightarrow \text{Max in } x \in \Sigma^* \\ \text{subject to} \\ P^x(F) &= 1. \end{aligned}$$

(註)  $P^x(F) = 1$  は  $P_{s_0}^x(F) = 1 \quad \forall s_0 \in S$  の意味。

Def. 非逐次的確率オートマトン

$\Sigma$  : input alphabet (finite set)

$S$  : state space (denumerable)

$L \subset \Sigma^*$  : language

$Q^* : L \rightarrow Q(S|S)$

$f$  : output function

このとき  $\mathcal{M} = (\Sigma, S, L, Q^*, f)$  を非逐次的確率オートマトンと云う。

Def. 非逐次的確率オートマトン  $\mathcal{M}$  における最適化問題は,

$$E^x f \rightarrow \text{Max in } x \in L$$

Def.  $\Pi = (\sigma(\Sigma, S, Q, F), g, k)$  が  $\mathcal{M} = (\Sigma, S, L, Q^*, f)$  を represent するとは,

$$(i) \quad L = \{x \in \Sigma^* \mid p^x(F) = 1\}$$

$$(ii) \quad E^x f = E^x(g + k) \quad \forall x \in L$$

Prop. 2 利得をもつ確率オートマトン  $\Pi$  を任意に与えると、自然な方法で  $\Pi$  は一つの非逐次的確率オートマトン  $\mathcal{M}$  を represent する。

Def.  $\Pi$  が "つき" の性質をもつとき, monotone であると言う:

任意の  $m$  に対し,

$$E^{\sigma_1 \dots \sigma_m} g \leq E^{\sigma'_1 \dots \sigma'_m} g$$

$$\text{ならば, } E^{\sigma_1 \dots \sigma_m \sigma_{m+1}} g \leq E^{\sigma'_1 \dots \sigma'_m \sigma_{m+1}} g \quad \forall \sigma_{m+1} \in \Sigma$$

が成立する。

Prop. 3  $\Pi$  が monotone なら, "つき" のことが成立する。

$$E^{\sigma_1 \dots \sigma_m} g \leq E^{\sigma'_1 \dots \sigma'_m} g$$

$$\text{ならば, } E^{\sigma_1 \dots \sigma_m \sigma_{m+1} \dots \sigma_n} g \leq E^{\sigma'_1 \dots \sigma'_m \sigma_{m+1} \dots \sigma_n} g$$

$$\forall (\sigma_{m+1} \dots \sigma_n) \in \Sigma^*, \quad \forall n \geq 1$$

Def.  $L \subset \Sigma^*$  に対して,  $L$  によって induce された  $\Sigma^*$  上の relation  $R_L$  を "つき" のように定義する:

$$x R_L y \stackrel{\text{def}}{\iff} \forall v \in \Sigma^* \text{ に対し } xv \in L \iff yv \in L$$

Prop. 4  $R_L$  は right congruent, equivalence relation である。

ただし right congruent とは

$$x \equiv y \Rightarrow xw \equiv yw \quad \forall w \in \Sigma^*$$

Def. equi-transition relation

$$x = (\sigma_1, \sigma_2, \dots, \sigma_n) \in \Sigma^* \text{ に対し, } Q(x) \equiv Q(\sigma_1)Q(\sigma_2) \cdots Q(\sigma_n)$$

$x, y \in \Sigma^*$  に対し, (ただし  $\lg x$  と  $\lg y$  は一致 (なくてよい)),

$Q(x) = Q(y)$  のとき  $x$  と  $y$  は equi-transition とする。

Prop. 5 equi-transition relation は right congruent かつ equivalence relation である, 任意の FCS に対し

$$L \equiv \{x \in \Sigma^* \mid P^x(F) = 1\}$$

とすると, equi-transition relation は  $R_L$  の細分である。

### 定理 1

$$L \subset \Sigma^*,$$

$\sim \in \Sigma^*$  上の right congruent equivalence relation である numerable rank とする。このとき,

$$L = \{x \in \Sigma^* \mid P^x(F) = 1\}$$

かつ  $\sim$  が  $\mathcal{O}$  の equi-transition relation

となるような 確率オートマトン  $\mathcal{O} = (\Sigma, S, Q, F)$  が存在するための 必要十分条件は,  $\sim$  が  $R_L$  の細分 となることである。

定理 2  $\mathcal{M} = (\Sigma, S, L, Q^*, f)$  を非逐次的確率オートマトン,  $\sim$  を  $\Sigma^*$  上の denumerable rank, equivalence relation とする。このとき  $\Pi$  が  $\mathcal{M}$  を represent し,  $\sim$  が  $\mathcal{O}$  上の equi-transition relation となるような monotone  $\Pi = (\mathcal{O}, g, k)$  が存在するための必要十分条件は つぎの (i) ~ (iii) が成立することである。

(i)  $\sim$  が  $R_L$  を 細分する。

(ii)  $x \sim y$  なら (a) または (b) のどちらか一方が成立

$$(a) \quad E^{xv}f \leq E^{yv}f \quad \forall v \text{ such that } xv \in L$$

$$(b) \quad E^{xv}f \geq E^{yv}f \quad \forall v \text{ such that } xv \in L$$

(iii)  $x \sim y, x \in L, y \in L, E^x f = E^y f$  ならば

$$E^{xv}f = E^{yv}f \quad \forall v \text{ such that } xv \in L$$

定理 3 monotone な, 利得をもつ確率オートマトン  $\Pi$  における最適化問題に対しては, "最適性の原理" が成立する。